

99 年上半年度風險值資訊

(一) 市場風險

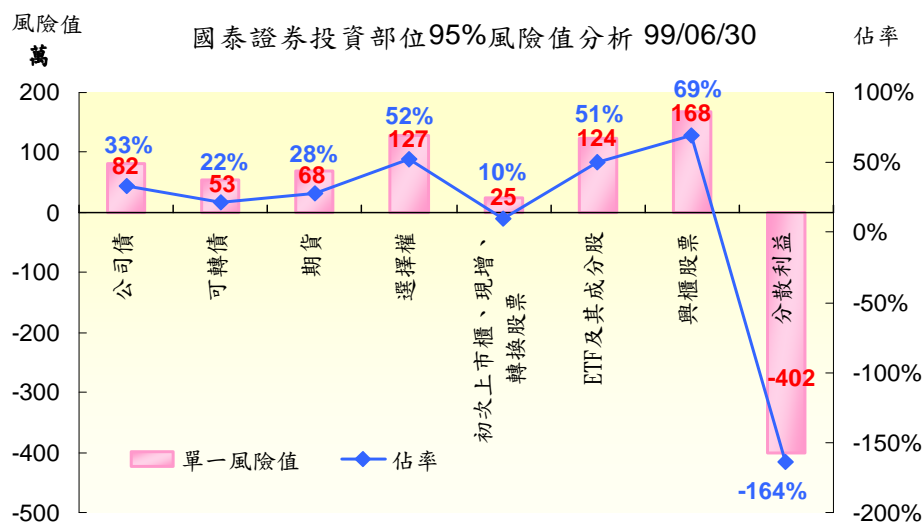
1. 控管模式

- ☑ 部位授權管理：訂定各業務/商品部位之部位限額、並透過下單系統管理，逾授權限額之委託單無法下單。
- ☑ 超缺避管理：訂定結構型商品及認購(售)權證之避險部位權限。
- ☑ 風險值管理：盤中進行初算、盤後以 Bloomberg 之「VAR」進行風險值運算。
- ☑ 警示/停損管理：設定各部位之警示、停損檢核點。
- ☑ 盤中即時監控系統：以即時監控系統管理各部位之風險值、損益與結構型商品、認購(售)權證之超缺避部位。

2. 風險值分析

全公司風險值分析

- ☑ 99/6/30 全公司 VaR 值為 244 萬，佔率最高為興櫃股票 69%，整體互抵效果達 164%。



- ☑ VaR/ VaR Limit 為 2.04%(VaR Limit 設定為 1.2 億，約佔公司淨值之 3%)。

- ☑ 99 年 1-6 月全公司風險值

